GUIA MODELO DE LA ASIGNATURA

Nombre	PORTAFOLIOS DE INVERSIÓN
Sigla	EA2041
Prerrequisitos	202039 PRODUCTOS DERIVADOS EA2039
Departamento	DEPARTAMENTO DE CIENCIAS ECONÓMICO-ADMINISTRATIVAS
Horas con docente	4
Horas independientes	2
Créditos	6

Perfil docente

Con estudios en	Finanzas, economía.
Grado académico	Maestría
Tiempo de experiencia	De 3 a 5 años

Fines de aprendizaje

Propone instrumentos diversificados de inversión en función a las condiciones de mercado, para el desarrollo de estrategias financieras.

Evidencia representativa de desempeño:

Portafolios diversificado con los criterios académicos y operando en simuladores.

Encuadre

El desarrollo de la asignatura deberá cumplir con las disposiciones vigentes, definidas en el Reglamento de Estudiantes de Licenciatura y considerar las orientaciones expresadas en la comunicación oficial “Orientaciones para la promoción del ambiente universitario"

Competencia generica

Competencia	Elemento
Competencia Digital	Autogestión del aprendizaje
Competencia Digital	Investigación y fluidez informacional
Creatividad, Innovación y Emprendimiento	Identificación de oportunidades
Creatividad, Innovación y Emprendimiento	Desarrollo de propuestas para la creación de valor.

Primer parcial

Primer parcial

Temas y subtemas

1. Generalidades.
1.1 Introducción.
1.2 Inversión.
1.3 Fundamentos de estadística.
2. Riesgo y rendimiento.
2.1 Medidas de riesgo y rendimiento.
2.2 Factores para determinar la tasa de retorno requerida.
2.3 Relación entre rendimiento y riesgo.

Actividades de aprendizaje con docente dentro de la institución

Actividad	Observación
Solución de problemas	
Ejercicios	
Análisis de resultados	
Revisión de material audiovisual o multimedia	

Actividades de aprendizaje con docente fuera de la institución

Actividad	Observación

Actividades de aprendizaje de manera independiente

Actividad	Observación
Resolución de problemas y ejercicios	
Elaboración, calificación o aplicación de instrumentos	
Elaborar formatos para registro y codificación de datos	
Desarrollo de portafolio	

Criterios del primer registro de evaluación

Actividad	Observación
Ejercicios	Ningún criterio deberá exceder el 40% del total de la evaluación parcial.
Portafolio	Ningún criterio deberá exceder el 40% del total de la evaluación parcial.
Un examen parcial	Ningún criterio deberá exceder el 40% del total de la evaluación parcial.

Segundo parcial

Temas y subtemas

1. Teoría de la administración de portafolios.
1.1 Principales supuestos.
1.2 El modelo de Markowitz y la teoría de la frontera eficiente.
2. Modelos de valuación de activos.
2.1 Activos libres de riesgo.
2.2 El portafolio de mercado.
2.3 Capital asset princing model, CAPM.

Actividades de aprendizaje con docente dentro de la institución

Actividad	Observación
Solución de problemas	
Ejercicios	
Análisis de resultados	
Revisión de material audiovisual o multimedia	

Actividades de aprendizaje con docente fuera de la institución

Actividad	Observación

Actividades de aprendizaje de manera independiente

Actividad	Observación
Resolución de problemas y ejercicios	
Elaboración, calificación o aplicación de instrumentos	
Elaborar formatos para registro y codificación de datos	
Desarrollo de portafolio	

Criterios del segundo registro de evaluación

Actividad	Observación
Ejercicios	Ningún criterio deberá exceder el 40% del total de la evaluación parcial.
Portafolio	Ningún criterio deberá exceder el 40% del total de la evaluación parcial.
Un examen parcial	Ningún criterio deberá exceder el 40% del total de la evaluación parcial.

Tercer parcial

Tercer parcial

Temas y subtemas

1. Índices de desempeño.
1.1 Índice de Treynor.
1.2 Índice de Sharpe.
1.3 Índice de Jensen.
1.4 Alfa.

Actividades de aprendizaje con docente dentro de la institución

Actividad	Observación
Solución de problemas	
Ejercicios	
Análisis de resultados	
Revisión de material audiovisual o multimedia	

Actividades de aprendizaje con docente fuera de la institución

Actividad	Observación

Actividades de aprendizaje de manera independiente

Actividad	Observación
Resolución de problemas y ejercicios	
Elaboración, calificación o aplicación de instrumentos	
Elaborar formatos para registro y codificación de datos	
Desarrollo de portafolio	

Evidencias de tercer parcial:

Evidencia	Observación
Portafolio	
Examen final	
Evaluaciones parciales	

Registro de la evaluación global:

Registro de la evaluación global:

Actividad	Valor	Observación
Portafolio	30 %	Operación de portafolios
Examen final	20 %	
Primer parcial	25 %	
Segundo parcial	25 %	
	100 %	

Recursos para el aprendizaje:

LIBRO

TÍTULO	Portafolios de Inversión Óptimos: Modelos y Algoritmos
NOMBRE DEL AUTOR	J.C.
APELLIDO DEL AUTOR	Arismendi
EDITORIAL	Editorial Académica Española
NÚMERO EDICIÓN	1a.
AÑO Y CIUDAD DE PUBLICACIÓN	2013, Alemania
IDENTIFICADOR EN BIBLIOTECA	---
TÍTULO	Managing Investment Portfolios: A Dynamic Process
NOMBRE DEL AUTOR	John L.
APELLIDO DEL AUTOR	Maginn
EDITORIAL	John Wiley & Sons
NÚMERO EDICIÓN	3a.
AÑO Y CIUDAD DE PUBLICACIÓN	2007, USA
IDENTIFICADOR EN BIBLIOTECA	---

Recursos Instrumentales o técnicos:

Recursos Tecnológicos:

Se cuenta con un espacio virtual de apoyo que es de carácter opcional a las clases presenciales, en un sistema de Gestión de aprendizaje (LMS, por sus siglas en inglés), para facilitar la comunicación, el seguimiento y la evaluación, posibilitando el desarrollo de proyectos colaborativos.